

撰写人：陈一兰 从业资格证号：F3010136 投资咨询从业证书号：Z0012698

| 项目类别 | 数据指标 | 最新 | 环比 | 数据指标 | 最新 | 环比 |
|------|--|-----------|----------|---|----------|----------|
| 期货市场 | CZCE ZC主力合约收盘价(日,元/吨) | 692.80 | +9.80↑ | CZCE ZC9-5价差(日,元/吨) | -1.4 | -6.40↓ |
| | CZCE ZC持仓量(日,手) | 28,539.00 | -247↓ | ZC前20名净持仓(上日,手) | -4325 | -109↓ |
| | ZC前20名多头(上日,手) | 15668 | -159↓ | ZC前20名空头(上日,手) | 19993 | -50↓ |
| 现货市场 | 秦皇岛港Q5500,S0.6,MT8山西(日,元/吨) | 950.00 | 0.00 | 山西晋城Q5500,A20,V9,S1.5,MT8车板含税价(日,元/吨) | 715.00 | 0.00 |
| | 广州港 Q5500,S0.4,MT17 内蒙古(日,元/吨) | 1,090.00 | 0.00 | 澳大利亚5500,A<22,V>25,S<1,MT10CFR不含税(日,美元/吨) | 144 | 0.00 |
| | CZCE ZC主力合约基差 (秦皇岛港)(日,元/吨) | 257.2 | -9.80↓ | | | |
| 产业情况 | 55港库存 (周,万吨) | 4,823.70 | -250.40↓ | 黄骅港库存 (周,万吨) | 180 | -17.00↓ |
| | 秦皇岛港库存 (周,万吨) | 449.00 | -25.00↓ | 广州港库存 (周,万吨) | 199.8 | +10.80↑ |
| | 曹妃甸港库存 (周,万吨) | 397.00 | -34.00↓ | 环渤海动力煤价格指数(周,元/吨) | 738.00 | +5.00↑ |
| | 动力煤产量(月,万吨) | 31,782.00 | +963.00↑ | 动力煤进口量(煤及褐煤)(月,万吨) | 3,505.00 | +811.00↑ |
| 下游情况 | 全国72家电厂样本区域存煤 (周,万吨) | 1,315.05 | +15.35↑ | 全国72家电厂样本区域存煤可用天数 (周,天) | 22.69 | +0.56↑ |
| | 全国72家电厂样本区域日耗 (周,万吨) | 57.96 | -0.78↓ | 全国发电量(月,亿千瓦时) | 6,540.40 | +146.90↑ |
| | 全国用电量(月,亿千瓦时) | 6,718.00 | +115.00↑ | 全国水力发电(月,亿千瓦时) | 901.00 | -292.70↓ |
| | 全国火力发电(月,亿千瓦时) | 4,645.00 | +381.30↑ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%) | 35.87 | -0.15↓ | 标的历史40日波动率(日,%) | 64.84 | +0.07↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 47.09 | -0.10↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 46.60 | +0.07↑ |
| 行业消息 | 1. 2021年, 湖北省全社会用电量2471.54亿千瓦时, 同比增长15.27%。分产业来看, 第一产业用电量28.64亿千瓦时, 同比增长25.15%, 比2019年增长26.30%; 第二产业用电量1517.07亿千瓦时, 同比增长16.77%, 比2019年增长12.68%; 第三产业用电量470.94亿千瓦时, 同比增长23.03%, 比2019年增长15.21%; 居民生活用电量454.88亿千瓦时, 同比增长3.55%, 比2019年增长4.22%。 2. 宁夏自治区生态环境厅制定出台了《宁夏回族自治区应对气候变化“十四五”规划》, 到2025年, 全区煤炭产能控制在1.4亿吨, 单位地区生产总值煤炭消耗下降15%, 燃煤电厂平均供电标准煤耗降低到300克/千瓦时以下。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 观点总结 | 动力煤现货价格企稳。近期因各地区疫情严峻, 煤矿管控政策加严。港口发运多以长协保供煤为主, 市场可流通现货资源少, 报价坚挺。临近春节假期叠加印尼出口禁令影响, 下游化工用户需求释放, 有少量补库。电厂依靠长协采购, 库存仍保持中高水平, 且日耗并无明显增加。技术上, ZC2205合约小幅反弹, 日MACD指标显示红色动能柱变化不大, 关注均线压力。操作建议, 可考虑在660-730元/吨区间操作, 止损各10个点。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 重点关注 | 1月14日, Mysteel 电厂煤炭库存、日耗量及可用天数 | | | | | |

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: ZC: 动力煤



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!